

**ИНФОРМАЦИЯ
СЪГЛАСНО ЧЛ. 72 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ
ДЕЙНОСТТА НА КИС, ИД ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УД****ДФ ТИ БИ АЙ ДИНАМИК**

Съгласно инвестиционната политика и стратегия на Фонда за инвестиране предимно в акции, търгувани на регулираните пазари в страната и чужбина, през периода продължават покупките и продажбите на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. Закупени и продадени са и чуждестранни инвестиции.

Към 30.11.2013г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 6 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.11.2013г. възлиза на 39.81%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 28.87% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.11.2013г. корпоративните облигации представляват 6.70% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 16.74% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.11.2013г. са 1.61% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, хеджиране, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 6.27% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.11.2013 г. е минус 1.43% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 13.93% , а доходността за последните 12 месеца към 29.11.2013г. е 16.20%.

I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44**1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти**

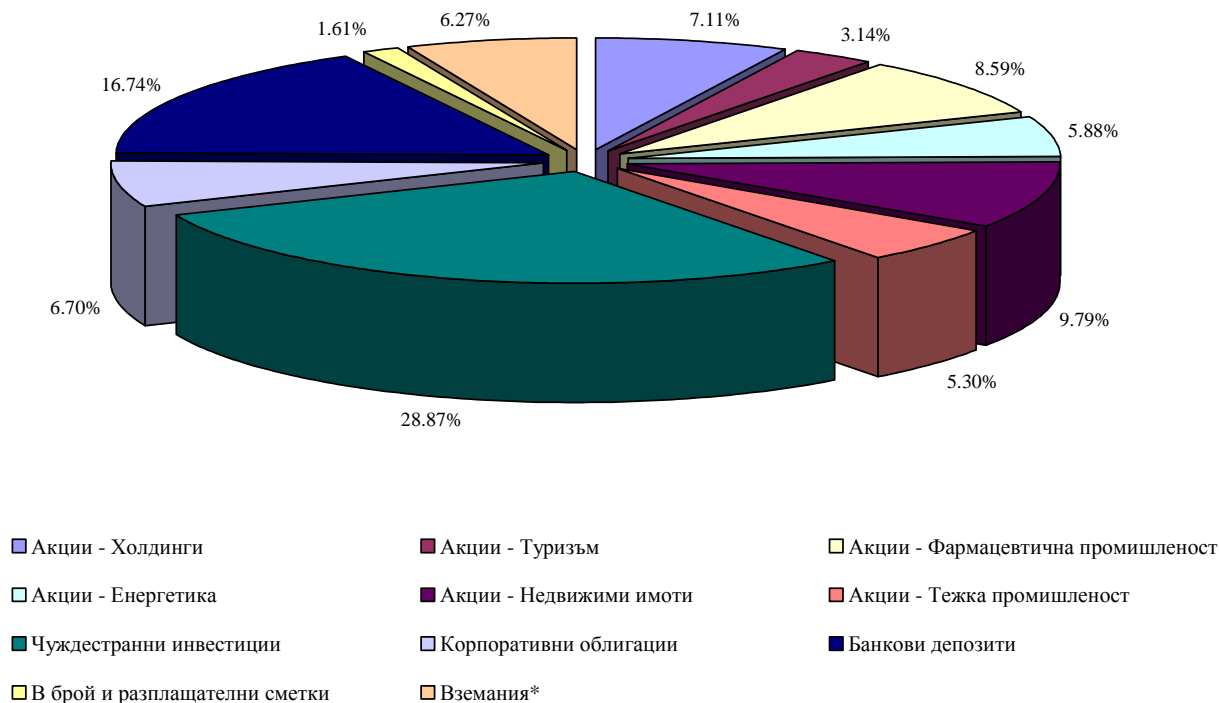
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30.11.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик" към 30.11.2013 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	137 303	7.11%
Акции - Туризм	60 631	3.14%
Акции - Фармацевтична промишленост	165 813	8.59%
Акции - Енергетика	113 515	5.88%
Акции - Недвижими имоти	189 075	9.79%
Акции - Тежка промишленост	102 331	5.30%
Чуждестранни инвестиции	557 266	28.87%
Корпоративни облигации	129 344	6.70%
Банкови депозити	323 173	16.74%
В брой и разплащателни сметки	31 075	1.61%
Вземания*	121 026	6.27%
Общо активи	1 930 552	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, платени такси към БФБ и КФН, вземания от хеджиране.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/11/2013



2) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 2: Видове деривативни инструменти, основни рискове, свързани с базовите активи на деривативните инструменти, количествени ограничения и избрани методи за оценка на риска, свързан със сделките с деривативни инструменти

Към настоящия момент, сключените от управляващото дружество сделки с деривативни инструменти са единствено с цел управление на риска – хеджиране.

Във връзка с притежаваните от Фонда валутно деноминирани активи, управляващото дружество извършва хеджиращи сделки с цел предпазване от валутния риск, на който е изложен Фонда. Хеджираните активи и сключените сделки са описани по-долу.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Парични средства във валута	USD	303.130	1.0000	\$303.13
US73935A1043	USD	570.000	85.730	\$48 866.10
US78462F1030	USD	449.000	181.000	\$81 269.00
Обща рискова позиция				\$130 438.23

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 96 000.00	1.344380	\$129 060.48	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$129 060.48		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД